

# 汇添富睿丰混合型证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

### (2018年第2号)

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

#### 重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可2017年2月15日【2017】223号文注册募集。本基金基金合同于2017年9月29日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的价值和收益作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资者拟认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，全面认识本基金产品的风险收益特征，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于连续大量赎回产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。本基金参与投资非公开发行股票，基金净值可能由于估值方法的原因偏离所持

有股票的收盘价所对应的净值。投资者在二级市场交易时，需考虑估值方法对基金净值的影响。

本基金根据收费方式的不同分为A类和C类两类基金份额。基金合同生效后，本基金在18个月封闭期内均不接受场内份额与场外份额的申购和赎回，但投资者可在其持有的基金份额上市交易后通过上海证券交易所转让基金份额。在证券市场持续下跌、基金二级市场交易不活跃等情形下，有可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响持有人收益或产生损失。

本基金可投资中小企业私募债券，中小企业私募债券属于高风险的债券投资品种，其流动性风险和信用风险均高于一般债券品种，会影响组合的风险特征。中小企业私募债券的流动性风险在于该类债券采取非公开方式发行和交易，由于不公开资料，外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能会降低市场对该类债券的认可度，从而影响该类债券的市场流动性。中小企业私募债券的信用风险在于该类债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大，同时，各类材料（包括募集说明书、审计报告）不公开发布，也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。

本基金为混合型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金，属于中等收益风险特征的基金。

本基金更新招募说明书“基金的投资”章节中有关“风险收益特征”的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行“销售适当性风险评价”，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的基金产品“风险等级评价”与“基金的投资”章节中“风险收益特征”的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回、基金份额上市交易、基金管理人委托的登记机构技术条件不允许等基金管理人无法予以控制的情形导致被动达到或者超过50%的除外。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书更新截止日为2018年9月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人简况

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室

办公地址：上海市富城路99号震旦国际大楼20楼

法定代表人：李文

成立时间：2005年2月3日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2005]5号

注册资本：人民币132,724,224元

联系人：李鹏

联系电话：021-28932888

股东名称及其出资比例：

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	24.656%
上海上报资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%

### （二）主要人员情况

## 1、董事会成员

李文先生，2015年4月16日担任董事长。国籍：中国，1967年出生，厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长，中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副局长、副局长，中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长，东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理，稽核总部总经理，东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理，汇添富基金管理股份有限公司督察长。

林福杰先生，2018年3月21日担任董事。国籍：中国，1971年出生，上海交通大学工商管理硕士。现任东航金控有限责任公司总经理、党委副书记、东航集团财务有限责任公司董事长。曾任东航期货有限责任公司部门经理，东航集团财务有限责任公司副总经理，国泰人寿保险有限责任公司副总经理，东航金控有限责任公司党委书记、副总经理。

程峰先生，2016年11月20日担任董事。国籍：中国，1971年出生，上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理，上海上报资产管理有限公司董事长，上海文化产权交易所股份有限公司董事长，上海瑞力投资管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记，上海机械进出口(集团)有限公司副总裁，上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长，上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长，上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任，上海国际集团有限公司行政管理总部总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长，上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

张晖先生，2015年4月16日担任董事，总经理。国籍：中国，1971年出生，上海财经大学数量经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理，汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师，富国基金管理有限公司高级分析师、研究主管和基金经理，汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资总监、投资决策委员会副主席，曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

韦杰夫 (Jeffrey R. Williams) 先生, 2007 年 3 月 2 日担任独立董事。国籍: 美国, 1953 年出生, 哈佛大学商学院工商管理硕士, 哈佛大学肯尼迪政府学院艾什民主治理与创新中心高级研究学者。现任美国中华医学基金会理事。历任美国花旗银行香港分行副总裁、深圳分行行长, 美国运通银行台湾分行副总裁, 台湾美国运通国际股份有限公司副总裁, 渣打银行台湾分行总裁, 深圳发展银行行长, 哈佛上海中心董事总经理。

林志军先生, 2015 年 4 月 16 日担任独立董事。国籍: 中国香港, 1955 年出生, 厦门大学经济学博士, 加拿大 Saskatchewan 大学工商管理理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼商学院院长、教授、博导。历任福建省科学技术委员会计划财务处会计, 五大国际会计师事务所 Touche Ross International (现为德勤) 加拿大多伦多分所审计员, 厦门大学会计师事务所副主任会计师, 厦门大学经济学院讲师、副教授, 伊利诺大学 (University of Illinois) 国际会计教育与研究中心访问学者, 美国斯坦福大学 (Stanford University) 经济系访问学者, 加拿大 Lethbridge 大学管理学院会计学讲师、副教授 (tenured), 香港大学商学院访问教授, 香港浸会大学商学院会计与法律系教授, 博导, 系主任。

杨燕青女士, 2011 年 12 月 19 日担任独立董事, 国籍: 中国, 1971 年出生, 复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑, 第一财经研究院院长, 国家金融与发展实验室特邀高级研究员, 上海政协委员, 《第一财经日报》创始编委之一, 第一财经频道高端对话节目《经济学人》等栏目创始人和主持人, 《波士堂》等栏目资深评论员。2002-2003 年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者。

## 2、监事会成员

任瑞良先生, 2004 年 10 月 20 日担任监事, 2015 年 6 月 30 日担任监事会主席。国籍: 中国, 1963 年出生, 大学学历, 会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管, 文汇新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。

王如富先生, 2015 年 9 月 8 日担任监事。国籍: 中国, 1973 年出生, 硕士研究生, 注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室

主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员，金信证券规划发展总部总经理助理、秘书处副主任（主持工作），东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东先生，2015年6月30日担任监事，国籍：中国，1978年出生，国际金融学硕士。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司，东航集团财务有限责任公司。

王静女士，2008年2月23日担任职工监事，国籍：中国，1977年出生，中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部，东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士，2008年2月23日担任职工监事，国籍：中国，1977年出生，华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监，汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生，2013年8月8日担任职工监事，国籍：中国，1979年出生，北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司，泰科电子（上海）有限公司能源事业部。

### 3、高管人员

李文先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

张晖先生，2015年6月25日担任总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

雷继明先生，2012年3月7日担任副总经理。国籍：中国，1971年出生，工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理，中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

娄焱女士，2013年1月7日担任副总经理。国籍：中国，1971年出生，金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作，负责投资银行、证券投资研究，以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，

现任公司副总经理。

袁建军先生，2015年8月5日担任副总经理。国籍：中国，1972年出生，金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理，汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理，并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生，2017年3月3日担任副总经理。国籍：中国，1969年出生，武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长，厦门建行信用卡部副处长、处长，厦门建行信息技术部处长，建总行北京开发中心负责人，建总行信息技术管理部副总经理，建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任，建总行信息技术管理部资深专员（副总经理级）。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生，2015年6月25日担任督察长。国籍：中国，1978年出生，上海财经大学经济学博士，历任上海证监局主任科员、副处长，上海农商银行同业金融部副总经理，汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

#### 4、基金经理

##### （1）现任基金经理

赵鹏飞先生，国籍：中国。10年证券从业经验。曾任职于日信证券、光大证券和太平洋资产，担任高级投资经理等岗位。2015年8月加入汇添富基金。2016年6月3日至今任汇添富多策略定开混合基金的基金经理，2017年3月20日至今任汇添富高端制造股票基金的基金经理，2017年9月27日至今任汇添富民丰回报基金的基金经理，2017年9月29日至今任汇添富弘安混合基金的基金经理，2017年9月29日至今任汇添富睿丰混合基金的基金经理，2018年3月19日至今任添富民安增益定开混合基金的基金经理，2018年4月23日至今任添富智能制造股票基金的基金经理。

蒋文玲女士，国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。12年证券从业经验。从业经历：曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员。2012年11月30日至2014年1月7日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014年1月

加入汇添富基金，历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014年4月8日至今任汇添富多元收益债券基金的基金经理助理，2015年3月10日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富优选回报混合基金（原理财21天债券基金）的基金经理，2015年3月10日至2018年5月4日任汇添富理财14天债券基金的基金经理，2016年6月7日至今任汇添富货币基金、添富通货币基金、实业债债券基金的基金经理，2016年6月7日至2018年5月4日任理财30天债券基金、理财60天债券基金的基金经理，2017年4月20日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理，2017年5月15日至今任添富年年益定开混合基金的基金经理，2017年6月23日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理，2018年8月2日至今任汇添富睿丰混合基金、汇添富新睿精选混合基金的基金经理。

## （2）历任基金经理

李怀定先生，2017年9月29日至2018年8月2日任汇添富睿丰混合型证券投资基金的基金经理。

## 5、投资决策委员会

主席：袁建军先生（副总经理）

成员：韩贤旺先生（首席经济学家）、王栩（权益投资总监）、陆文磊（总经理助理，固定收益投资总监）、劳杰男（研究副总监）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号



托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

## （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60% 以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

## （三）证券投资基金托管情况

截至 2018 年 6 月 30 日，中国银行已托管 674 只证券投资基金，其中境内基金 638 只，QDII 基金 36 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

## 三、相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、场外销售机构

##### （1）直销机构

#### 1) 汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932823

传真：（021）50199035 或（021）50199036

联系人：陈卓膺

客户服务电话：400-888-9918（免长途话费）

网址：[www.99fund.com](http://www.99fund.com)

2) 汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统（[trade.99fund.com](http://trade.99fund.com)）

（2）其他场外销售机构

1) 中国银行股份有限公司

公司全称：中国银行股份有限公司

法定代表人：陈四清

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

2) 招商银行股份有限公司

公司全称：招商银行股份有限公司

法定代表人：李建红

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

客户服务电话：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

3) 中国光大银行股份有限公司

公司全称：中国光大银行股份有限公司

法定代表人：李晓鹏

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

客服电话：95595

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

4) 上海银行股份有限公司

公司全称：上海银行股份有限公司

法定代表人：金煜

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

客户服务电话：95594

网址：[www.bosc.cn](http://www.bosc.cn)

5) 宁波银行股份有限公司

公司全称：宁波银行股份有限公司

法定代表人：陆华裕

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

客户服务电话：95574

网址：[www.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.cn)

6) 上海农村商业银行股份有限公司

公司全称：上海农村商业银行股份有限公司

法定代表人：胡平西

注册地址：上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20 楼、22-27 楼

办公地址：上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20 楼、22-27 楼

客服电话：021-962999 4006962999

公司网站：[www.srcb.com](http://www.srcb.com)

7) 爱建证券有限责任公司

公司全称：爱建证券有限责任公司

法定代表人：祝健

注册地址：世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 32 楼

办公地址：世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 32 楼

客户服务电话：4001-962-502

网址：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

8) 安信证券股份有限公司

公司全称：安信证券股份有限公司

法定代表人：王连志

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

客服电话：95517

公司网站地址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

9) 渤海证券股份有限公司

公司全称：渤海证券股份有限公司

法定代表人：王春峰

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

客户服务电话：400-651-5988

网址：[www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

10) 财富证券有限责任公司

公司全称：财富证券有限责任公司

法定代表人：蔡一兵

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26、27、28 楼

客服电话：95317

网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

11) 财通证券股份有限公司

公司全称：财通证券股份有限公司

法定代表人：沈继宁

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

客服电话：95336

公司网址：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

12) 长城国瑞证券有限公司

公司全称：长城国瑞证券有限公司

法定代表人：王勇

注册地址：厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址：厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼

客户服务电话：400-0099-886

网址：[www.gwgsc.com](http://www.gwgsc.com)

13) 长城证券股份有限公司

公司全称：长城证券股份有限公司

法定代表人：丁益

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

客服电话：400-6666-888

公司网站：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

14) 长江证券股份有限公司

公司全称：长江证券股份有限公司

法定代表人：尤习贵

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

客服热线：95579

网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

15) 大同证券有限责任公司

公司全称：大同证券有限责任公司

法定代表人：董祥

注册地址：山西省大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层

客服电话：4007-121212

网站地址：[www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

16) 德邦证券股份有限公司

公司全称：德邦证券股份有限公司

法定代表人：武晓春

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 29 楼

客服电话：400-8888-128

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

## 17) 第一创业证券股份有限公司

公司全称：第一创业证券股份有限公司

法定代表人：刘学民

注册地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层

办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

客服电话：95358

网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

## 18) 东方证券股份有限公司

公司全称：东方证券股份有限公司

法定代表人：潘鑫军

注册地址：上海市中山南路318号国际金融广场2号楼22层-29层

办公地址：上海市中山南路318号国际金融广场2号楼22层-29层

客户服务热线：95503

东方证券网站：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

## 19) 东海证券股份有限公司

公司全称：东海证券股份有限公司

法定代表人：赵俊

注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

## 20) 东吴证券股份有限公司

公司全称：东吴证券股份有限公司

法定代表人：范力

注册地址：江苏省苏州市苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦

办公地址：江苏省苏州市苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦

客服电话：95330

网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

## 21) 东兴证券股份有限公司

公司全称：东兴证券股份有限公司

法定代表人：魏庆华

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

客服电话：95309

公司网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

22) 光大证券股份有限公司

公司全称：光大证券股份有限公司

法定代表人：薛峰

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

客户服务电话：95525

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

23) 广州证券股份有限公司

公司全称：广州证券股份有限公司

法定代表人：胡伏云

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、  
20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、

20 层

客服电话：95396

公司网站：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

24) 国都证券股份有限公司

公司全称：国都证券股份有限公司

法定代表人：王少华

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

客服电话：400-818-8118

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

25) 国金证券股份有限公司

公司全称：国金证券股份有限公司

法定代表人：冉云

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

客户服务电话：95310

网址：[www.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

26) 国融证券股份有限公司

公司全称：国融证券股份有限公司

法定代表人：张智河

注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

办公地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道与呈祥路交汇处武川  
立农村镇银行股份有限公司四楼

客服电话：95385

网址：[www.rxzq.com.cn](http://www.rxzq.com.cn)

27) 国泰君安证券股份有限公司

公司全称：国泰君安证券股份有限公司

法定代表人：杨德红

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

客服电话：95521

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

28) 国信证券股份有限公司

公司全称：国信证券股份有限公司

法定代表人：何如

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

客户服务电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

29) 海通证券股份有限公司

公司全称：海通证券股份有限公司

法定代表人：周杰



注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

客服电话：95553、4008888001、021-95553

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

### 30) 华安证券股份有限公司

公司全称：华安证券股份有限公司

法定代表人：章宏韬

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

客户服务电话：95318

网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

### 31) 华宝证券有限责任公司

公司全称：华宝证券有限责任公司

法定代表人：陈林

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

客户服务电话：400-820-9898

网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

### 32) 华福证券有限责任公司

公司全称：华福证券有限责任公司

法定代表人：黄金琳

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 9 层（福州行政总部）

客户服务电话：95547

公司网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

### 33) 华龙证券股份有限公司

公司全称：华龙证券股份有限公司

法定代表人：孙耀志

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

客服电话：95368、400-6898888

公司网址：[www.hlzq.com](http://www.hlzq.com)

34) 华融证券股份有限公司

公司全称：华融证券股份有限公司

法定代表人：祝献忠

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 至 18 层

客服电话：95390

网址：[www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

35) 华鑫证券有限责任公司

公司全称：华鑫证券有限责任公司

法定代表人：俞洋

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元

客服电话：95323

公司网址：<http://www.cfsc.com.cn/>

36) 江海证券有限公司

公司全称：江海证券有限公司

法定代表人：孙名扬

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

客户服务热线：400-666-2288

网址：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

37) 九州证券股份有限公司

公司全称：九州证券股份有限公司

法定代表人：魏先锋

注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号

办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园东一门 2 号楼

客服电话：95305

网址：<http://www.jzsec.com>

## 38) 开源证券股份有限公司

公司全称：开源证券股份有限公司

法定代表人：李刚

注册地址：陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

办公地址：陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

客服电话：95325、400-860-8866

公司网址：[www.kysec.cn](http://www.kysec.cn)

## 39) 联储证券有限责任公司

公司全称：联储证券有限责任公司

法人：沙常明

注册地址：广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路333号金砖大厦8层

客服电话：400-620-6868

公司网站：[www.lczq.com](http://www.lczq.com)

## 40) 联讯证券股份有限公司

公司全称：联讯证券股份有限公司

法定代表人：徐刚

注册地址：中国广东省惠州市惠城区江北东江三路广播电视新闻中心

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、  
四楼

联系电话：95564

网址：[www.lxzq.com.cn](http://www.lxzq.com.cn)

## 41) 南京证券股份有限公司

公司全称：南京证券股份有限公司

法定代表人：步国旬

注册地址：南京市玄武区大钟亭8号

办公地址：南京市江东中路389号

客服电话：95386

网址：[www.njzq.com.cn](http://www.njzq.com.cn)

## 42) 平安证券股份有限公司

公司全称：平安证券股份有限公司

法定代表人：刘世安

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层；

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层；

全国免费业务咨询电话：95511-8、4000-188-288

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

43) 上海证券有限责任公司

公司全称：上海证券有限责任公司

法定代表人：李俊杰

注册地址：上海市西藏中路 336 号华旭国际大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

客户服务电话：（021）962518、4008918918（全国热线）

公司网站：[www.962518.com](http://www.962518.com)

44) 申万宏源西部证券有限公司

公司全称：申万宏源西部证券有限公司

法定代表人：韩志谦

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

客户服务电话：400-800-0562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

联系人：李巍

45) 申万宏源证券有限公司

公司全称：申万宏源证券有限公司

法定代表人：李梅

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

客服电话：95523 或 4008895523 或 021-33389888

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

## 46) 世纪证券有限责任公司

公司全称：世纪证券有限责任公司

法定代表人：姜昧军

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

客服热线：400-832-3000

网站：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

## 47) 万联证券股份有限公司

公司全称：万联证券股份有限公司

法定代表人：张建军

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

客服电话：400-8888-133

网址：[www.wlzq.cn](http://www.wlzq.cn)

## 48) 西南证券股份有限公司

公司全称：西南证券股份有限公司

法定代表人：吴坚

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

客户服务电话：95355

网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

## 49) 新时代证券股份有限公司

公司全称：新时代证券股份有限公司

法定代表人：叶顺德

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

客服电话：95399

网址：[www.xsdzq.cn](http://www.xsdzq.cn)

## 50) 信达证券股份有限公司

公司全称：信达证券股份有限公司

法定代表人：张志刚

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

客服电话：95321

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

51) 兴业证券股份有限公司

公司全称：兴业证券股份有限公司

法定代表人：杨华辉

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区长柳路36号

客服电话：95562

公司网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

52) 中国银河证券股份有限公司

公司全称：中国银河证券股份有限公司

法定代表人：陈共炎

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

客服电话：95551 或 4008-888-888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

53) 招商证券股份有限公司

公司全称：招商证券股份有限公司

法定代表人：霍达

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

客户服务电话：95565、4008888111

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

54) 中航证券有限公司

公司全称：中航证券有限公司

法定代表人：王宜四

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

客户服务电话：95335 或 400-88-95335

网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

55) 中国国际金融有限公司

公司全称：中国国际金融有限公司

法定代表人：丁学东

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

公司网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

56) 中泰证券股份有限公司

公司全称：中泰证券股份有限公司

法定代表人：李玮

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

客服电话：95538

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

57) 中天证券股份有限公司

公司全称：中天证券股份有限公司

法定代表人：马功勋

注册地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

办公地址：沈阳市和平区南五马路 121 号万丽城晶座 4 楼中天证券经纪事业部

客服电话：（024）95346

公司网站：[www.iztzq.com](http://www.iztzq.com)

58) 中国中投证券有限责任公司

公司全称：中国中投证券有限责任公司

法定代表人：高涛

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

客服电话：400-600-8008、95532

网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

59) 中信建投证券股份有限公司

公司全称：中信建投证券股份有限公司

法定代表人姓名：王常青

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

客服电话：400-8888-108

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

60) 中信证券股份有限公司

公司全称：中信证券股份有限公司

法定代表人：张佑君

注册住址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

客服电话：95548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

61) 中信证券（山东）有限责任公司

公司全称：中信证券（山东）有限责任公司

法定代表人：杨宝林

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号青岛金融广场 1 号楼 20 层

(266061)

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 2 层

客户服务电话：95548

公司网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

62) 中银国际证券有限责任公司

公司全称：中银国际证券有限责任公司

法定代表人：宁敏

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层



办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

客户服务电话：400-620-8888

公司网址：[www.bocichina.com](http://www.bocichina.com)

63) 大泰金石基金销售有限公司

公司全称：大泰金石基金销售有限公司

法定代表人：袁顾明

注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆  
2105 室

办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆  
2105 室

客服电话：4009282266

网站：[www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

64) 厦门市鑫鼎盛投资有限公司

公司全称：厦门市鑫鼎盛投资有限公司

法定代表人：林松

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

客户服务电话：400-918-0808

网址：[www.xds.com.cn](http://www.xds.com.cn)

65) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

公司全称：上海长量基金销售投资顾问有限公司

法定代表人：张跃伟

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场 2 期 11 层

客服电话：400-820-2899

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

66) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

公司全称：宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

法定代表人：戎兵

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 18 层 1809

客户服务热线：400-6099-200

公司网站：www.yixinfund.com

67) 众升财富（北京）基金销售有限公司

公司全称：众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

法定代表人：王斐

客服电话：400-876-9988

网址：www.wy-fund.com

68) 北京钱景基金销售有限公司

公司全称：北京钱景基金销售有限公司

法定代表人：赵荣春

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

客户服务电话：4008936885

公司网址：www.qianjing.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售基金，并及时公告。

## 2、场内销售机构

本基金办理场内认购、申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格，且经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位。具体会员单位名单可在上海证券交易所网站查询。

本基金募集结束前获得基金销售资格的上海证券交易所会员单位可通过上海证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。基金管理人将不就此事项进行公告。

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-58598839

传真：010-58598907

联系人：朱立元

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

邮政编码：100738

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

业务联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、许培菁

#### 四、基金的名称

本基金名称：汇添富睿丰混合型证券投资基金

## 五、基金的类型

本基金为契约型开放式混合型基金。

## 六、基金的投资目标

本基金主要投资于债券等固定收益类资产，并通过投资股票等权益类资产增强收益，在科学严格管理风险的前提下，力争创造超越业绩比较基准的长期稳健收益。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的30%。封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

## 八、基金的投资策略

本基金将密切关注市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，判断不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，以动态调整大类资产配置比例。在此基础上，灵活运用债券投资策略、股票精选策略等。

封闭期内，本基金采取的投资策略主要为资产配置策略、债券投资策略、定向增发策略、定增破发策略、股票精选策略等；转为上市开放式基金后，本基金采取的投资策略主要为资产配置策略、债券投资策略、股票精选策略等。

### 1、资产配置策略

本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素（其中，基本面因素包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据；政策面因素包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等货币政策、政府购买总量、转移支付水平以及税收政策等财政政策；市场面因素包括市场参与者情绪、市场资金供求变化、市场 P/E 与历史平均水平的偏离程度等），结合全球宏观经济形势，研判国内外经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例。

### 2、债券投资策略

#### （1）利率策略

本基金将通过全面研究和分析宏观经济运行情况 and 金融市场资金供求状况变化趋势及结构，结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判，从而预测出金融市场利率水平变动趋势。在此基础上，结合期限利差与凸度综合分析，制定出具体的利率策略。

具体而言，本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标，分析宏观经济情况，建立经济前景的场景模拟，进而预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时，本基金还将分析金融市场资金供求

状况变化趋势与结构，对影响资金面的因素进行详细分析与预判，建立资金面的场景模拟。

在此基础上，本基金将结合历史与经验数据，区分当前利率债收益率曲线的期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位，判断收益率曲线参数变动的程度与概率，即对收益率曲线平移的方向，陡峭化的程度与凸度变动的趋势进行敏感性分析，以此为依据动态调整投资组合。如预期收益率曲线出现正向平移的概率较大时，即市场利率将上升，本基金将降低组合久期以规避损失；如出现负向平移的概率较大时，则提高组合久期；如收益率曲线过于陡峭时，则采用骑乘策略获取超额收益。本基金还将在对收益率曲线凸度判断的基础上，利用蝶形策略获取超额收益。

## （2）信用策略

信用债券收益率是与其具有相同期限的无风险收益率加上反映信用风险收益的信用利差之和。基准收益率主要受宏观经济环境的影响，信用利差收益率主要受对应的信用利差曲线以及该信用债券本身的信用变化的影响，因此本基金分别采用基于信用利差曲线变化策略和基于信用变化的策略。

### 1) 基于信用利差曲线变化的策略

本基金将以下两方面分析信用利差的变化情况，并采取相应的投资策略：

宏观经济环境对信用利差的影响：当宏观经济向好时，信用利差可能由于发债主体盈利能力改善而收窄；反之，信用利差可能扩大。本基金将根据宏观经济的变化情况，加大对信用利差收窄的债券的投资比例。

市场供求关系对信用利差的影响：信用债券的发行利率、企业的融资需求等都将影响债券的供给，而政策的变化、其他类属资产的收益率等也将影响投资者对信用债券的需求，从而对信用利差产生影响。本基金将综合分析信用债券市场容量、市场形势预期、流动性等因素，在具有不同信用利差的品种间进行动态调整。

### 2) 基于信用变化的策略

本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。

为了准确评估发债主体的信用风险，我们设计了定性和定量相结合的内部

信用评级体系。内部信用评级体系遵循从“行业风险”—“公司风险”（包括公司背景、公司行业地位、企业盈利模式、公司治理结构和信息披露状况、及企业财务状况）—“外部支持”（外部流动性支持能力及债券担保增信）—“得到评分”的评级过程。其中，定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析，主要包括四个方面：盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量信息的分析和研究，作为定量分析的重要补充，能够有效提高定量分析的准确性。

本基金内部的信用评级体系定位为即期评级，侧重于评级的准确性，从而为信用产品的实时交易提供参考。本基金会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪，发掘相对价值被低估的债券，以便及时有效地抓住信用债券本身信用变化带来的市场交易机会。

### 3) 个券选择策略

本基金将根据信用债券市场的收益率水平，在综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，建立收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型，并通过这些模型进行估值，重点选择具备以下特征的信用债券：较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善，以及价值尚未被市场充分发现的个券。

#### （3）可转换债券投资策略

对于本基金中可转债的投资，本基金主要采用可转债相对价值分析策略。

由于可转债兼具债性和股性，其投资风险和收益介于股票和债券之间，可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。

其次，在进行可转债筛选时，本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析，这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等，形成对基础股票的价值评估。本基金将可转债自身的基本面分析和其基础股票的基本面分析结合在一起，最终确定投资的品种。

#### （4）中小企业私募债券投资策略

本基金将在严格控制信用风险的基础上，通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券，并通过组

合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险，实现投资收益的最大化。

本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础，结合定性和定量方法，注重对企业未来偿债能力的分析评估，对中小企业私募债券进行分类，以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度，并及时跟踪其信用风险的变化。

本基金对中小企业私募债券的投资策略以持有到期为主，在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下，重点选择资质较好、收益率较好的中小企业私募债券进行投资。

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

### 3、股票精选策略

#### (1) “自下而上”精选策略

本基金将采用“自下而上”的策略，精选出具有持续竞争优势且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得当期的较高投资收益。

本基金将结合定量评估、定性分析和估值分析来综合评估备选公司的投资价值。主要考虑三方面因素：

1) 竞争优势：企业的竞争优势是企业获得长期增长的根本动力。本基金对企业竞争优势的分析将从企业的技术、管理、品牌和成本等各方面综合考虑。同时结合时代特点，本基金重点分析企业的市场优势和科研能力：

市场优势：本基金将选择具有市场优势的企业，主要是指公司现在或未来有可能在行业细分市场中占据较大的市场份额，或拥有较高的市场份额增长率。

科研能力：本基金将选择那些具有核心技术优势的上市公司。考虑的因素包括：产品技术含量、技术发展前景、技术成熟程度、研究经费投入规模、配套政策支持、研究成果转化的经济效果等。



2) 成长性：本基金对企业成长性的分析从内生增长和外延并购两个方面进行分析。内生增长即通过分析企业的商业模式、竞争优势、行业前景等方面来选择业绩增速最快、持续性更强的公司。外延增长分析即通过整体上市、并购重组等方式实现经营规模扩张的公司，以及被并购价值、资产或品牌价值明显、被并购后能够出现经营改善、利润水平大幅提高的公司。

3) 公司治理：本基金对公司治理结构的评估，主要是对上市公司经营管理层面的组织和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察，包括对所有权和经营权的分离、对股东利益的保护、经营管理的自主性、政府及母公司对公司内部的干预程度，管理决策的执行和传达的有效性，股东会、董事会和监事会的实际执行情况，企业改制彻底性、企业内部控制的制订和执行情况等。

4) 财务稳定：本基金对企业财务稳定性的分析将包括定量及定性两方面。在定量的分析方法上，我们主要参考主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、净资产收益率（ROE）、毛利率等财务指标。同时，基于定性的公司基本面分析对公司未来盈利状况进行预测，综合考虑行业前景、下游需求、市场地位和财务结构等方面进行判断。

5) 估值合理：本基金基于动态静态指标相结合的原则，采用内在价值、相对价值、收购价值相结合的评估方法，如市盈增长比率（PEG）、市盈率（P/E）、市净率（P/B）、企业价值/息税前利润（EV/EBIT）、企业价值/息税、折旧、摊销前利润（EV/EBITDA）、自由现金流贴现（DCF）等，对价值股票库中的优质公司进行价值评估，并在此基础上建立核心价值股票库。

基金经理根据本基金的投资决策程序，审慎精选，权衡风险收益特征后，构建投资组合并动态调整。

#### 4、定向增发策略

定向增发是指上市公司向特定投资者（包括大股东、机构投资者、自然人等）非公开发行业股票的融资方式。本基金将对进行非公开发行的上市公司进行基本面分析，综合分析定向增发项目目的、定向增发对象结构、定向增发项目类别等因素，并结合市场未来走势进行判断，精选定向增发股票。在定向增发股票锁定期结束后，本基金将根据对股票内在投资价值和成长性的判断，结合股票市场环境的分析，选择适当的时机卖出。封闭期内，本基金将定向增发作

为股票资产投资的主要策略；转为上市开放式基金后，本基金将在严格管理风险的前提下审慎参与定向增发。

#### 5、定增破发策略

定增破发是指股票交易价格跌破之前定增发行价格的情形。基金管理人将择机参与定增破发上市公司，以获取超额收益。对于定增破发股票，本基金将综合考虑上市公司基本面、定向增发条款、破发幅度、解禁时间、市场情绪等因素来构建投资组合。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，以在控制风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

在资产支持证券的选择上，本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的策略。“自上而下”投资策略指在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，本基金运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对收益率走势及其收益和风险进行判断。“自下而上”投资策略指运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

#### 7、金融衍生工具投资策略

本基金将基于谨慎原则运用权证、股指期货、国债期货、股票期权等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金将通过对权证标的证券的基本面进行研究，结合多种定价模型和投资策略，根据基金资产组合情况适度进行权证的投资。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，以降低交易成本和组合风险，提高投资效率。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势

和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

#### 8、融资投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

本基金将密切跟踪国内关于基金参与融券及转融通业务法律法规的实施进展，待基金参与融券及转融通业务的相关规定颁布后，将在届时相应法律法规的框架内，制订符合本基金投资目标的投资策略。同时结合对融券及转融通的研究，在充分考虑风险和收益特征的前提下，谨慎进行投资。

未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明更新中公告。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的 30%；

(2) 封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；本基金所指的现金不包括结算备

付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金参与股指期货和国债期货交易，应当遵守下列要求：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基

基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

3) 封闭期内，本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；本基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(16) 因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购股票期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽股票期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵股票期权保证金的现金等价物；未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；基金投资股票期权应符合基金合同约定的比例限制（如股票仓位、个股占比等）、投资目标和风险收益特征；

(17) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(18) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%，且其剩余期限不得超过本基金的剩余封闭期；

(19) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(20) 封闭期内，本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；转为上市开放式基金（LOF）后，本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(21) 转为上市开放式基金（LOF）后，本基金主动投资流动性受限资产的市值合计不得超过本基金基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(22) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认可的特殊投资组合除外）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；同一基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；

(23) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手方开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

(24) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第（2）、（12）、（21）、（23）项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

本基金持有证券期间，如发生证券处于流通受限状态等非基金管理人原因导致基金投资比例不符合前述规定的，基金管理人应在上述情形消除后的 10 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合

基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## 九、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%

选择该业绩比较基准，是基于以下因素：

- 1、沪深 300 指数和中债综合指数合理、透明；
- 2、沪深 300 指数和中债综合指数具有较高的知名度和市场影响力；

3、沪深 300 指数和中债综合指数有一定市场覆盖率，且不易被操纵；

4、沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数；

5、中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，为中国全市场债券指数，其以 2001 年 12 月 31 日为基期，基点为 100 点，并于 2002 年 12 月 31 日起发布。中债综合指数的样本具有广泛的市场代表性，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成分债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类，能较好地反映债券市场的整体收益；

6、基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制机构调整或停止上述指数的发布，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场中出现更具有代表性的业绩比较基准，或者更科学的业绩比较基准，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，变更本基金的业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金，属于中等收益风险特征的基金。



## 十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

### 投资组合报告

#### 1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	58,611,257.40	10.48
	其中：股票	58,611,257.40	10.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	482,020,920.40	86.16
	其中：债券	482,020,920.40	86.16
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,815,092.90	1.93
8	其他资产	8,031,104.10	1.44
9	合计	559,478,374.80	100.00

#### 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	15,591,866.00	4.63
C	制造业	16,323,617.74	4.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	26,695,773.66	7.93
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	58,611,257.40	17.41

### 1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	2,707,963	14,406,363.16	4.28
2	601939	建设银行	1,859,300	12,178,415.00	3.62
3	601699	潞安环能	1,000,000	9,260,000.00	2.75
4	002236	大华股份	400,000	9,020,000.00	2.68
5	002466	天齐锂业	145,600	7,220,304.00	2.14
6	601225	陕西煤业	770,300	6,331,866.00	1.88
7	601990	南京证券	10,230	110,995.50	0.03
8	603013	亚普股份	2,573	83,313.74	0.02

**1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	465,011,564.30	138.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	17,009,356.10	5.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	482,020,920.40	143.19

**1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	143526	18 老窖 01	200,000	20,182,000.00	6.00
2	143576	18 光证 G2	200,000	20,096,000.00	5.97
3	143570	18 兵器 01	200,000	20,036,000.00	5.95
4	136078	15 禹洲 01	200,000	19,876,000.00	5.90
5	136297	16 两江 01	200,000	19,788,000.00	5.88

**1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

**1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

### 1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 1.11 投资组合报告附注

### 1.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 1.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	62,305.41
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	7,968,798.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,031,104.10

**1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113014	林洋转债	6,316,800.00	1.88
2	110033	国贸转债	3,835,586.10	1.14
3	128029	太阳转债	2,787,370.00	0.83
4	128024	宁行转债	2,092,200.00	0.62
5	113015	隆基转债	1,506,398.40	0.45

**1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

**十二、基金的业绩**

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

**睿丰 A**

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差	比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	(1)-(3)	(2)-(4)
----	----------	----------	---------	--------------	---------	---------

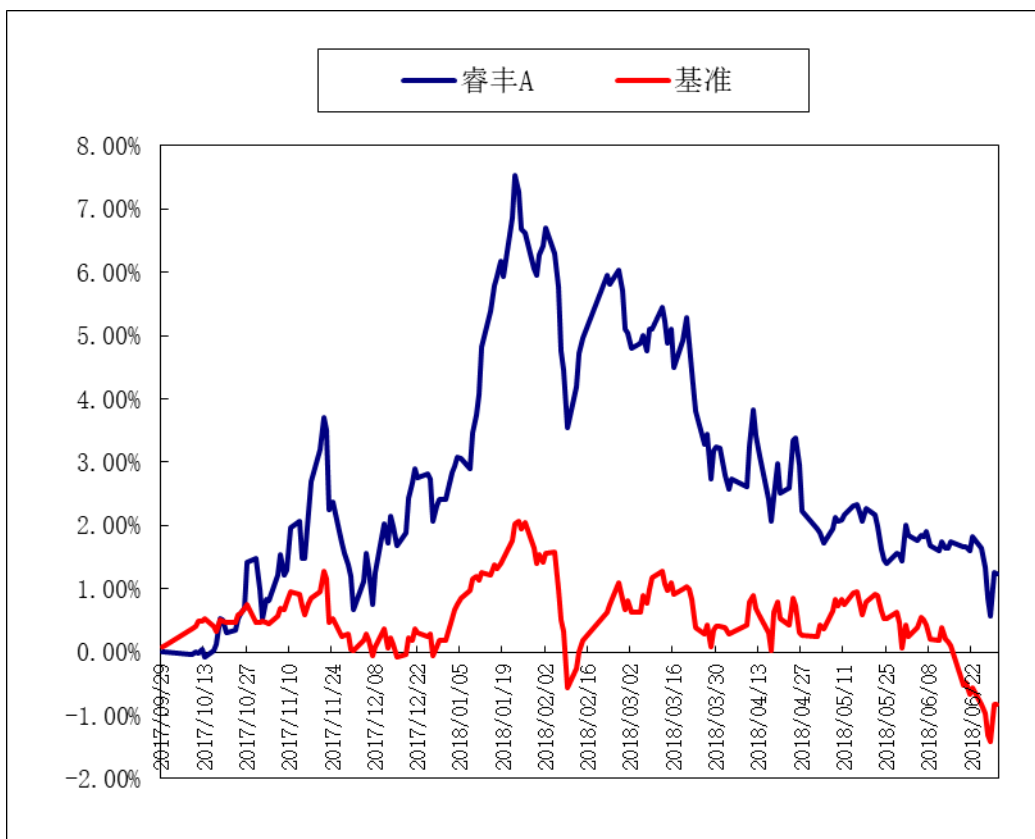
		(2)	(3)	(4)		
2017年9月29日 (基金合同生效日) 至2017年12月 31日	2.41%	0.38%	0.19%	0.16%	2.22%	0.22%
2018年1月1日至 2018年6月30日	-1.14%	0.37%	-0.85%	0.23%	-0.29%	0.14%
2017年9月29日 (基金合同生效日) 至2018年6月30日	1.24%	0.37%	-0.82%	0.21%	2.06%	0.16%

**睿丰 C**

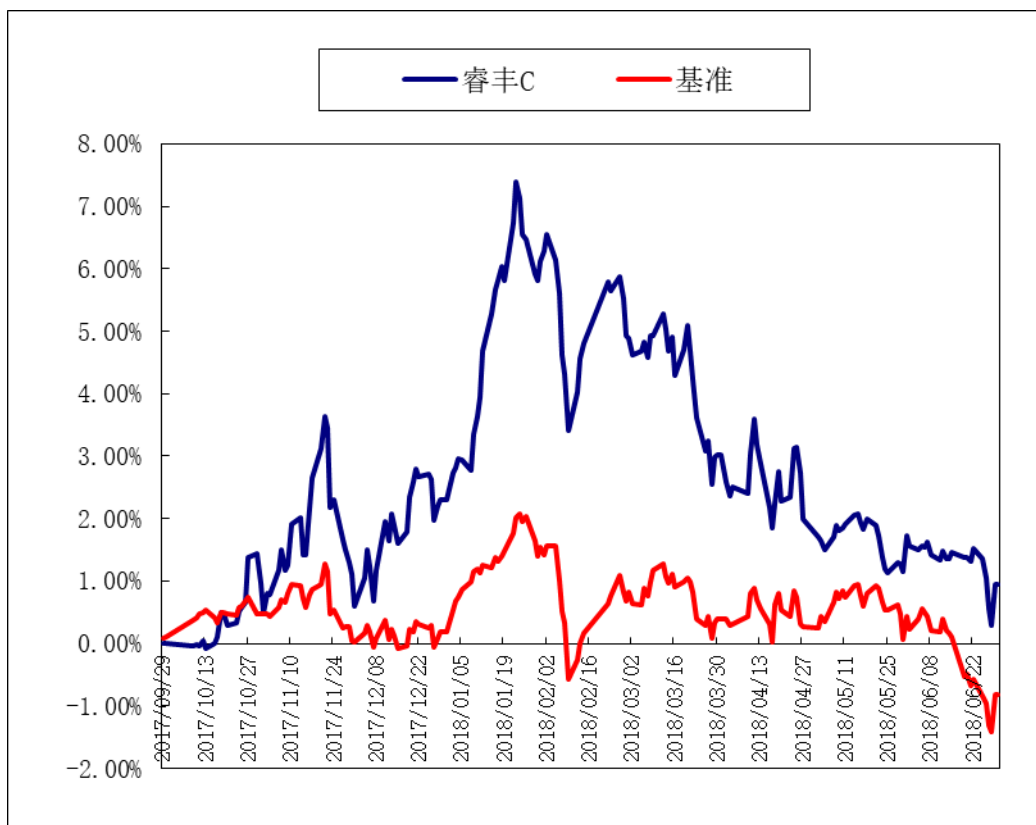
阶段	净值增长率 (1)	净值增长率 标准差 (2)	比较基准 收益率 (3)	业绩比较基准收 益率标准差 (4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2017年9月29日 (基金合同生效日) 至2017年12月 31日	2.31%	0.38%	0.19%	0.16%	2.12%	0.22%
2018年1月1日至 2018年6月30日	-1.34%	0.37%	-0.85%	0.23%	-0.49%	0.14%
2017年9月29日 (基金合同生效日) 至2018年6月30日	0.94%	0.37%	-0.82%	0.21%	1.76%	0.16%

(二) 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较图

**睿丰 A**



睿丰 C



### 十三、基金的费用与税收

#### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费：本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、基金上市费及年费；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等情形，顺延至法定节假日、公休日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。



## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等情形，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

## 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等情形，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

#### 一、“重要提示”部分：

增加了对基金持有人持有份额上限限制，更新了招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日。

#### 二、“二、释义”部分：

增加了《流动性风险管理规定》和流动性受限资产的释义。

#### 三、“三、基金管理人”部分：

更新了基金管理人的相关信息。

#### 四、“四、基金托管人”部分：

更新了基金托管人的相关信息。

#### 五、“五、相关服务机构”部分：

更新了相关服务机构的相关信息。

#### 六、“九、基金份额的申购和赎回”部分

更新了基金申购与赎回的数额限制、申购费用和赎回费用、拒绝或暂停申购的情形、暂停赎回或延缓支付赎回款的情形和巨额赎回的处理方式。

#### 七、“十、基金的投资”部分：

更新了投资组合限制和基金投资组合报告。

**八、“十一、基金的业绩”部分：**

更新了基金业绩表现数据。

**九、“十三、基金资产估值”部分：**

更新了暂停估值的情形。

**十、“十七、基金的信息披露”部分：**

更新了基金定期报告需披露的内容。

**十一、“十八、风险揭示”部分：**

更新了流动性风险及风险管理方法说明。

**十二、“二十一、基金托管协议的内容摘要”部分：**

根据托管协议更新了托管协议内容摘要。

**十三、“二十三、其他应披露事项”部分：**

增加了 2018 年 3 月 30 日至 2018 年 9 月 29 日期间涉及本基金的相关公告。

汇添富基金管理股份有限公司

2018 年 10 月 30 日